

Chấm điểm công ty quản lý quỹ theo 4 loại A,B,C,D

(NDHMoney) Ủy ban Chứng khoán Nhà nước (UBCKNN) vừa công bố dự thảo Quy chế hướng dẫn đánh giá, xếp loại công ty quản lý quỹ và đang lấy ý kiến các thành viên thị trường để xây dựng hệ thống quản lý giám sát dựa trên rủi ro.



Theo dự thảo của UBCKNN, việc đánh giá các công ty quản lý quỹ sẽ sử dụng quy chuẩn CAMELS bao gồm đánh giá qua các chỉ tiêu vốn (capital), chất lượng tài sản (assets), năng lực quản trị (management), kết quả kinh doanh (earning) và khả năng thanh khoản (liquidity).

Các đánh giá này sẽ giúp phân loại nhằm cảnh báo sớm, theo dõi giám sát hoạt động của các công ty quản lý quỹ, nắm bắt kịp thời thực trạng và có biện pháp xử lý kịp thời đối với các công ty hoạt động yếu kém, gặp nhiều rủi ro.

Cách chấm điểm những như tiêu chí đánh giá đưa ra sẽ hỗ trợ cho công tác quản lý, hoạch định chính sách và công tác thanh tra của UBCKNN, bảo vệ tính vẹn toàn của TTCK.

Về cách tính điểm, điểm tổng hợp sẽ bằng tổng trọng số chỉ tiêu nhân với điểm chỉ tiêu, trong đó điểm chỉ tiêu là giá trị bình quân gia quyền của các nhân tố cấu thành chỉ tiêu đó.

Trong 5 chỉ tiêu đánh giá thì chỉ tiêu về vốn và năng lực quản trị chiếm trọng số cao nhất (cùng chiếm 30%), tiếp theo mới đến kết quả kinh doanh (trọng số 20%) và cuối cùng là chất lượng tài sản và khả năng thanh toán.

Đối với chỉ tiêu về vốn, đánh giá 4 nhân tố về tỷ lệ vốn khả dụng (trọng số 40%), tiếp theo là tỷ lệ vốn chủ sở hữu/vốn pháp định, lãi lỗ lũy kế/vốn điều lệ; tỷ lệ đầu tư tài chính trên vốn chủ sở hữu (trọng số 20%).

Việc xếp loại các công ty quản lý quỹ được căn cứ trên điểm tổng hợp và các điểm nhân tố của từng công ty theo 4 loại A, B, C, D theo thang điểm tổng hợp từ 80, 65, 50 điểm trở lên và dưới 50 điểm.

Trong vòng 15 ngày kể từ ngày nhận được báo cáo bán niên, báo cáo tài chính năm, báo cáo chỉ tiêu an toàn tài chính, UBCKNN có trách nhiệm tổng hợp, đánh giá, xếp loại các công ty quản lý quỹ.

Anh Minh - NDHMoney